

CLASIFICACION: ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE NACIONAL
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 27/01/2022

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Industriales					
1	ASUR	B	ALTB	2,168,474.68	1.81%
1	BIMBO	A	ALTB	2,226,297.96	1.86%
1	CEMEX	CPO	ALTB	9,108,654.28	7.63%
1	CUERVO	*	ALTB	705,690.74	0.59%
1	FEMSA	UBD	ALTB	10,089,854.10	8.45%
1	GCC	*	ALTB	2,448,010.52	2.05%
1	GMEXICO	B	ALTB	7,930,256.07	6.64%
1	GRUMA	B	ALTB	4,336,999.20	3.63%
1	KIMBER	A	ALTB	1,181,790.06	0.99%
1	KOF	UBL	ALTB	1,614,653.60	1.35%
1	ORBIA	*	ALTB	4,276,962.95	3.58%
1	PINFRA	*	ALTB	964,024.86	0.80%
1	VESTA	*	ALTB	746,237.12	0.62%
				47,797,906.14	
				47,797,906.14	
Comerciales					
1	ALSEA	*	ALTB	481,453.38	0.40%
1	WALMEX	*	ALTB	15,133,612.72	12.68%
				15,615,066.10	
				15,615,066.10	
Servicios					
1	BOLSA	A	ALTB	478,723.36	0.40%
1	GAP	B	ALTB	5,289,592.95	4.43%
1	GFNORTE	O	ALTB	12,811,501.65	10.73%
1	OMA	B	ALTB	3,633,055.08	3.04%
1	Q	*	ALTB	581,056.77	0.48%
1	R	A	ALTB	1,246,159.20	1.04%
				24,040,089.01	
				24,040,089.01	

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

CLASIFICACION: ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE NACIONAL
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 27/01/2022

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Otros					
1	AC	*	ALTB	4,492,457.22	3.76%
1	ALFA	A	ALTB	3,606,946.70	3.02%
1	GCARSO	A1	ALTB	669,012.00	0.56%
				8,768,415.92	
				8,768,415.92	
Comunicaciones y Transportes					
1	AMX	L	ALTB	16,253,294.64	13.73%
1	MEGA	CPO	ALTB	590,383.84	0.49%
1	TLEVISA	CPO	ALTB	3,615,477.84	3.02%
				20,459,156.32	
				20,459,156.32	
Reportos					
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	2,652,482.16	2.22%
				2,652,482.16	
				2,652,482.16	
CARTERA TOTAL:				119,333,115.65	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			4.000 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.5250 %		

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.